

TOGETHERMORE

REALE GROUP

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ITALIANA LINEA FUTURO SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2023 Allegato 1

ATTIVITA'	Situazione al 3	1-12-2023	Situazione a fine esercizio precedente		
ATTIVITA	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività	
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	57.270.208,26	93,82	38.678.359,95	92,36	
A1.Titoli di debito	12.793.716,40	20,96	7.374.261,88	17,61	
A1.1. Titoli di Stato	12.793.716,40	20,96	7.374.261,88	17,61	
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili					
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi					
A2. Titoli azionari	44.476.491,86	72,86	31.304.098,07	74,75	
A3. Parti di O.I.C.R.					
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI					
B1. Titoli di debito					
B1.1. Titoli di Stato					
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili					
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi					
B2. Titoli azionari					
B3. Parti di O.I.C.R.					
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI					
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)					
C1.1. Warrant					
C1.2. Diritti su partecipazioni in portafoglio					
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)					
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA'					
MONETARIE					
E. DEPOSITI BANCARI	3.688.584,17	6,04	3.161.330,22	7,54	
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare			19.505,77	0,05	
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				•	
H, ALTRE ATTIVITA'	85.504,93	0,14	19.087,73	0,05	
H1. Ratei attivi	67.172,64	0,11	18.007,82	0,04	
H2. Altri attivi (da specificare)	18.332,29	0,03	1.079,91	0,01	
H2.1. Crediti d'imposta					
H2.2. Crediti per ritenute	18.332,29	0,03	1.079,91	0,01	
H2.3. Commissioni Retrocedute					
H2.4. Crediti tax reclaim		_			
TOTALE ATTIVITA'	61.044.297,36	100,00	41.878.283,67	100,00	

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31	-12-2023	Situazione a fine esercizio precedente		
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale	
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI					
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)					
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)					
I2.1. Interest rate swap					
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE	-326.913,51	51,41	-65.610,32	23,61	
M. ALTRE PASSIVITA'	-308.937,37	48,59	-212.308,25	76,39	
M1. Ratei passivi					
M2. Spese pubblicazione quota					
M3. Spese revisione rendiconto					
M4. Commissione di gestione	-308.937,37	48,59	-212.308,25	76,39	
M5. Passività diverse					
TOTALE PASSIVITA'	-635.850,88	100,00	-277.918,57	100,00	
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		60.408.446,48		41.600.365,10	
Numero delle quote in circolazione		5.160.499,270		4.065.217,258	
Valore unitario delle quote		11.705		10.233	

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	398.840,300	237.968,277	237.060,190	498.875,988
Quote rimborsate	54.796,581	58.663,006	50.451,001	113.552,155

Milano, 19/02/2024

Il Rappresentante della Società

Jone Law Tien





TOGETHERMORE

REALE GROUP

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ITALIANA LINEA FUTURO SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2023 Allegato 2

SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2023				
	Rendiconto al 31-12-2023		Rendiconto esercizio	
	rendreshts di 51 1	2 2025	precedente	
A. STRUMENTI FINANZIARI				
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	1.265.070,94		838.986,49	
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	118.464,27	<u> </u>	37.593,74	
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	1.146.606,67		801.392,75	
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.				
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	569.873,09		-2.404.141,97	
A2.1 Titoli di debito	119.037,10		-164.260,29	
A2.2. Titoli azionari	450.835,99		-2.239.881,68	
A2.3. Parti di O.I.C.R.				
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	5.872.850,45		-2.648.590,96	
A3.1. Titoli di debito	430.787,35		-892.466,94	
A3.2. Titoli di capitale	5.442.063,10		-1.756.124,02	
A3.3. Parti di O.I.C.R.				
Risultato gestione strumenti finanziari	7.7	07.794,48		-4.213.746,44
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
B1. RISULTATI REALIZZATI				
B1.1. Su strumenti negoziati				
B1.2. Su strumenti non negoziati				
B2. RISULTATI NON REALIZZATI				
B2.1. Su strumenti negoziati				
B2.2. Su strumenti non negoziati				
Risultato gestione strumenti finanziari derivati			•	
C. INTERESSI ATTIVI	70,508,79		4.153,51	
C1. SU DEPOSITI BANCARI	70.508,79		4.153,51	
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI				
D1. RISULTATI REALIZZATI				
D2. RISULTATI NON REALIZZATI				
E. PROVENTI SU CREDITI				
F. ALTRI PROVENTI				
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE				
ATTIVI				
F2. PROVENTI DIVERSI				
Risultato lordo della gestione di portafoglio	7.7	78.303.27		-4,209,592,93
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-120.246,87	. 5.555,21	-103.058,85	
G1. Bolli, spese e commissioni	-120.246,87		-103.058,85	
Risultato netto della gestione di portafoglio		58.056,40		-4.312.651,78
H. ONERI DI GESTIONE	-1.141.506,90	30.030,40	-783.729,39	4.512.051,70
H1. Commissione di gestione	-1.135.009,76		-778.686,18	
H2. Spese pubblicazione quota	-1.133.007,70	<b>⊢</b>	-770.000,10	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-8.00	<b>⊢</b>	-8.00	
H4. Altri oneri di gestione	-6.489.14	<b>⊢</b>	-5.035.21	
I. ALTRI RICAVI E ONERI	17.400,45		24.692,52	
II. Altri ricavi	17.400,45	<b>⊢</b>	24.692,52	
I2. Altri ricavi	17.400,45	<del>                                     </del>	24.092,32	
Utile/perdita della gestione del Fondo	(5	33,949,95		-5.071.688,65
Uthe/peruna dena gestione dei Fondo	0.5	33.949,93		-5.0/1.088,05

## SEZIONE DI CONFRONTO \*

Milano, 19/02/2024

SEZIONE DI CONFRONTO				
Rendimento della gestione	14,38	Volatilità della gestione		8,60
Rendimento del benchmark	16,35	Volatilità del benchmark **		
Differenza	-1,97	Volatilità dichiarata ***	15,00	/ 20,00
* Per le imprese che hanno adottato un benchm	ark ** indic	cate soltanto in caso di gestione passiva	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	

<sup>\*</sup> Per le imprese che hanno adottato un benchmark \*\*\* indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO \*

| Rendimento della gestione | Volatilità della gestione | Volatilità dichiarata | Volatilità della gestione | Volatilità dichiarata | Volatilità dichi

Il Rappresentante della Società

Jano Lan rien.

<sup>\*</sup> Per le imprese che non hanno adottato un benchmark